



TITLE:

動的計画の並[平]行合成について (最適化理論とその関連分野)

AUTHOR(S):

岩本, 誠一

CITATION:

岩本, 誠一. 動的計画の並[平]行合成について(最適化理論とその関連分野). 数理解析研究所講究録 1991, 747: 108-121

ISSUE DATE:

1991-04

URL:

<http://hdl.handle.net/2433/102241>

RIGHT:

動的計画の並行合成について

九大・経済 岩本誠一 (Seiichi Iwamoto)

1. 概要

R. Bellman の動的計画法は、目的関数の単調性と可分性の下で多変数同時最適化を一連の決定を含む状態変換列の下での多段最適化によって行う逐次最適化手法である[1, 4-7, 9, 10]。可分性を持たない目的関数の逐次最適化の例として分数計画問題[11, 12]がある。この目的関数は、加法型関数/加法型関数 なる分数型合成関数である。また、R. Bellman の著書には目的関数として 加法型関数+最大型関数 なる加法型合成関数[1,p.55; 2,p.31; 3,p.134]が見られる。これらは2つの関数の $h(x,y)=x/y$ または $x+y$ による合成関数である。このとき、合成される個々の加法型関数、最大型関数はともに単調性と可分性をもっている。しかし、合成された関数自身には両性質は消えている。

本論文では、上述の2つの合成関数を含む複合関数の族の逐次最適化を考える。まず、第2節では有限段確定的動的計画 D を逐次最適化機械として定義する。これは逐次状態変換の下での最適化問題を表現している。第3節では、同じ段数をもつ2つの動的計画 D_1, D_2 と2変数関数 h を与えておく。このとき、 h によって合成された最適化問題を表現する動的計画 $h(D_1, D_2)$ を導入する。これを動的計画の平行合成という。第4節では、平行合成された動的計画の例として散布度最小化問題を有限段グラフ上で考える。バラツキなどの分散最小化問題はいわゆる最短ルート問題の次に位置している問題と考えられる。特に、統計的散布度として範囲、分散、比の3つをそれぞれ最小化する。したがって、グラフ上での最小範囲ルート、最小分散ルート、最小比ルートを動的計画の最適解3点(最適利得関数列、最適政策、最適行動)を求めることによってそれぞれ求める。

2. 動的計画

この節では以下の定式化に必要な有限段確定的動的計画を逐次最適化として定義しておこう。有限段確定的動的計画(Dynamic Program, DP) D は順序づけられた5つ組

$$D = (Opt, \{S_n\}_1^{N+1}, \{A_n\}_1^N, (\{f_n\}_1^N, k, \otimes), \{T_m\}_1^N)$$

で与えられる[4-7]。ただし、

- (i) N は正の整数で段の総数を表す。 n は段を示すパラメータである。
- (ii) S_n は空でない集合で、第 n 状態空間という。この元を s_n, s_n^* などを書く。通常、 s_1 を初期状態、 s_{N+1} を終端状態という。
- (iii) A は空でない集合。さらに、 $2^{A_n} = \{\text{集合 } A_n \text{ の空でない部分集合}\}$ として、 $A_n(\cdot) : S_n \rightarrow 2^{A_n}$ とする。すなわち、各 $s_n \in S_n$ に対して $A_n(s_n)$ は集合 A_n の空でない部分集合である。ここに記号 A_n を集合と点対集合値写像の両方に用いていることに注意する。集合 A_n を第 n 決定空間、 $(A_n \supset) A_n(s_n)$ を s_n における可能な決定空間という。 $A_n(s_n)$ の元を a_n, a_n^* など表す。写像 $A_n(\cdot)$ のグラフ $G_r(A_n)$ を

$$G_r(A_n) = \{(s_n, a_n) \mid a_n \in A_n(s_n), s_n \in S_n\} \quad 1 \leq n \leq N$$

で定義する

(iv) $f_n : G_r(A_n) \rightarrow R^1$ を第 n 利得関数、 $k : S_{N+1} \rightarrow R^1$ を終端利得関数という。ただし、 R^p は p 次元ユークリッド空間である。 \otimes は 2 項演算である。すなわち、ある空でない部分集合 $R \subset R^1$ に対して、演算 $\otimes : R \times R \rightarrow R$ は結合的

$$(a \otimes b) \otimes c = a \otimes (b \otimes c)$$

かつ、第 2 変数に関して単調非減少

$$b_1 < b_2 \Rightarrow a \otimes b_1 < a \otimes b_2$$

とする。このとき、3 つ組 $(\{f_n\}_1^N, k, \otimes)$ を利得系という。

(v) $T_n : G_r(A_n) \rightarrow S_{n+1}$ を第 n 状態変換という。

(vi) Opt は Max か min のいずれか一方を指示する最適子で、次の最適化問題を表現していることを意味する。

$$\begin{aligned} & \text{Opt } \bigotimes_{n=1}^N g_n(s_n, a_n) \otimes k(s_{N+1}) \\ & \text{s.t. (i) } T_n(s_n, a_n) = s_{n+1} \quad \text{(ii) } a_n \in A_n(s_n) \quad 1 \leq n \leq N \end{aligned} \quad (1)$$

ただし、この目的関数は

$$g_1(s_1, a_1) \otimes g_2(s_2, a_2) \otimes \cdots \otimes g_N(s_N, a_N) \otimes k(s_{N+1})$$

を略記したものである。

以上が、問題としての動的計画自身の導入である。ここで、利得系について若干コメントしておこう。すなわち、利得系に含まれる 2 項演算の結合性が利得の再帰性を導き、ひいては動的計画の可分性を与えている。他方、2 項演算の単調非減少性が動的計画のいわゆる単調性を保証している。一般論として、2 項演算 \otimes を用いずに利得系を定式化できるが[4-7]、本論文では以下の合成や応用例を考慮して、2 項演算を含む型で利得系を導入しておくことにする。ただ、ここでは利得系の定式化・導入にはいくつかの可能な方法があることを注意しておこう。

次に、 N 段 DP D の解に相当する部分を導入しよう。さて、有限列 $\{\pi_n\}_1^N$ が D の政策とは、各 $\pi_n : S_n \rightarrow A_n$ が $\pi_n(s_n) \in A_n(s_n)$ $s_n \in S_n$, $1 \leq n \leq N$ となるときをいう。政策 $\{\pi_n\}_1^N$ が s_1 における D の最適政策とは、各初期状態 s_1 、状態変換列 $\{T_n\}_1^N$ 、および政策 $\{\pi_n\}_1^N$ から一意に定まる状態と決定の列 $\{s_1, a_1^*, s_2^*, a_2^*, \dots, s_N^*, a_N^*, s_{N+1}^*\}$ すなわち

$$\begin{aligned} a_1^* &= \pi_1^*(s_1), \quad s_2^* = T_1(s_1, a_1^*), \quad a_2^* = \pi_2^*(s_2^*), \quad \dots, \quad a_N^* = \pi_N^*(s_N^*), \\ s_{N+1}^* &= T_N(s_N^*, a_N^*) \end{aligned}$$

が、最適化問題 (1) の最適値を与えるときをいう。各 $s_1 \in S_1$ における D の最適政策を単に D の最適政策という。最適値を与える列 $\{s_1, a_1^*, s_2^*, \dots, s_N^*, s_{N+1}^*\}$ を D の s_1 からの最適行動という。一般に、状態と決定から成る交互列 $\{s_1, a_1, s_2, a_2, \dots, s_N, s_{N+1}\}$ を行動といい、特に (1) の制約条件を満たしているとき、すなわち

$$a_n \in A_n(s_n), \quad T_n(s_n, a_n) = s_{n+1} \quad 1 \leq n \leq N$$

のとき、可能な行動という。

N段DP D

$$D = (Opt, \{S_n\}_1^{N+1}, \{A_n\}_1^N, (\{f_n\}_1^N, k, \otimes), \{T_n\}_1^N)$$

が与えられたとき、各 n ($1 \leq n \leq N$) に対して、 D_n を

$$D_n = (Opt, \{S_m\}_n^{N+1}, \{A_m\}_n^N, (\{f_m\}_n^N, k, \otimes), \{T_m\}_n^N)$$

で定義する。D は、 $s_n \in S_n$ を初期状態とし、 $s_{N+1} \in S_{N+1}$ を終端状態とする (N-n+1) 段DPであり、最適化問題

$$\begin{aligned} & Opt \bigotimes_{m=n}^N f_m(s_m, a_m) \otimes k(s_{N+1}) \\ & \text{s.t. (i) } T_m(s_m, a_m) = s_{m+1} \quad \text{(ii) } a_m \in A_m(s_m) \quad n \leq m \leq N \end{aligned} \quad (2)$$

を表現している。したがって、特に $D = D_1$ である。DP D_n の政策、最適政策、行動などは D の場合と同様に定義される。問題 (2) の最適値を $u^{N-n+1}(s_n)$ で表す。

$$u^{N-n+1}(s_n) = Opt \bigotimes_{a_m: (i) \atop m=n}^N f_m(s_m, a_m) \otimes k(s_{N+1})$$

関数 $u^{N-n+1}: S_n \rightarrow R^1$ を D_n の最適値関数という。特に、

$$u^0(s_{N+1}) = k(s_{N+1})$$

としておく。列 $\{u^n\}_0^N$ を DP D の最適値関数列という。動的計画の解は、与えられたDP D に対してその最適利得関数列、最適政策、最適行動の3点から成る最適解を求めることである。ただ、前述の様に最適行動は最適政策と状態変換列から一意に定まるから、本質的には最適利得関数列と最適政策の2点を求めることで十分である。この2点は次の再帰式を解くことによって求められる。

定理1 ([6]) (i) 最適利得関数列は次の再帰を満たす。

$$\begin{cases} u^0(s_{N+1}) = k(s_{N+1}) \\ u^{N-n+1}(s_n) = Opt_{a_n \in A_n(s_n)} f_n(s_n, a_n) \otimes u^{N-n}(T_n(s_n, a_n)) \end{cases} \quad s_n \in S_n, \quad 1 \leq n \leq N$$

(ii) 各 n , 各 s_n に対して (i) の最適点 a_n を $\pi_n^*(s_n)$ とすると、列 $\{\pi_n^*\}_1^N$ は最適政策である。

3. 動的計画の平行合成

$$\left\{ \begin{array}{l} p, q \in R^I, s_{N+1} \in S_{N+1}, u_{N+1} \in U_{N+1}, \\ w^{N-N+1}(s_n, p, u_n, q) = \underset{\substack{a_n \in A_n(s_n) \\ b_n \in B_n(u_n)}}{\text{Opt}} w^{N-n}(T_n(s_n, a_n), p \oplus f_n(s_n, a_n), V_n(u_n, b_n), \\ q \oplus g_n(u_n, b_n)) \\ p, q \in R^I, s_n \in S_n, u_n \in U_n, 1 \leq n \leq N \end{array} \right.$$

が成り立つ。

(ii) 与問題(4)は終端利得関数のみをもつN段DP D_3 で表現される:

$$D_3 = (\text{Opt}, \{ S_n \times R^I \times U_n \times R^I \}_1^{N+1}, \{ A_n \times B_n \}_1^N, (\{ h_n \}_1^N, m, \oplus), \{ p_n \}_1^N)$$

ただし、

$$(A_n \times B_n)(s_n, p, u_n, q) = \{ (a_n, b_n) \mid a_n \in A_n(s_n), b_n \in B_n(u_n) \},$$

$$h_n(s_n, p, u_n, q; a_n, b_n; s_{n+1}, p', u_{n+1}, q') = 1, \quad a \oplus b = b,$$

$$m(s_{n+1}, p, u_{n+1}, q) = h(p \oplus k(s_{n+1}), q \oplus l(u_{n+1})),$$

$$p_n(s_n, p, u_n, q; a_n, b_n) = (T_n(s_n, a_n), p \oplus f_n(s_n, a_n),$$

$$V_n(u_n, b_n), q \oplus g_n(u_n, b_n)).$$

このとき、 D_3 を

$$D_3 = h(D_1, D_2)$$

と表し、 D_1, D_2 の h による平行合成 (parallel composition) という。

4. グラフ上での複合関数の最適化

この節では動的計画の平行合成の例として、有限グラフ上での複合関数の最適値を再帰式を解いて求める。さて、前述のN段DP D_1 は最適化問題

$$\text{Opt} \bigotimes_{n=1}^N f_n(s_n, a_n) \otimes k(s_{N+1})$$

$$\text{s.t. (i) } T_n(s_n, a_n) = s_{n+1}, \text{ (ii) } a_n \in A_n(s_n) \quad 1 \leq n \leq N$$

を表現していた。ここで、二項演算 \otimes が特に $+$, \times , \vee , \wedge のときは、この最適化問題の目的関数はそれぞれ

$$\begin{array}{ll}
\text{加法型} & \sum_{n=1}^N f_n(s_n, a_n) + k(s_{N+1}) \\
\text{乗法型} & \prod_{n=1}^N f_n(s_n, a_n) \times k(s_{N+1}) \quad \text{ただし} \quad f_n(s_n, a_n) \geq 0 \\
& \quad \quad \quad k(s_{N+1}) \geq 0 \\
\text{最大型} & \bigvee_{n=1}^N f_n(s_n, a_n) \vee k(s_{N+1}) \\
\text{最小型} & \bigwedge_{n=1}^N f_n(s_n, a_n) \wedge k(s_{N+1})
\end{array}$$

になる([6, p.15])。ここでは、これらの目的関数を含む(1)を単一問題という。これに対して、 h で合成された最適化問題

$$\begin{aligned}
\text{Opt } h & \left(\bigotimes_{n=1}^N f_n(s_n, a_n) \otimes k(s_{N+1}), \bigoplus_{n=1}^N g_n(s_n, a_n) \oplus l(s_{N+1}) \right) \\
\text{s.t. } & (i) T_n(s_n, a_n) = s_{n+1}, \quad (ii) a_n \in A_n(s_n) \quad 1 \leq n \leq N
\end{aligned} \quad (6)$$

を2つの評価関数の合成問題という。一般に、 n 個の評価関数の合成問題は n 個の N 段DPの n 変数関数

$$h : \overbrace{R^1 \times R^1 \times \cdots \times R^1}^n \rightarrow R^1$$

による平行合成で表される。ただし、 n 個のDPの状態空間列、決定空間列、状態変換列はそれぞれ共通であるとする。

4.1 最小範囲問題

図1において点Aから出発して左→右の方向に進んで点Nで終わるとする。このとき、いわゆる最短ルート問題 [8, p.77] やこれを広義化した単一最適化問題 [7; p.2, p.15, p.20] が自然に考えられる。

ここでは、2つの評価関数 最大型関数 $x = \bigvee_{n=1}^5 g_n(x_n, x_{n+1})$ と 最小型関数 $y = \bigwedge_{n=1}^5 g_n(x_n, x_{n+1})$ との差 $h = x - y$ によって合成された複合関数を、統計学におけるデータのバラツキを表す範囲 range として考える。例えば、図1のルート $A \rightarrow B \rightarrow E \rightarrow I \rightarrow L \rightarrow N$ の範囲は 最大値 - 最小値 = $11 - 2 = 9$ である。特に、部分ルート $B \rightarrow E \rightarrow I$ を含むルートの範囲は 9 である。

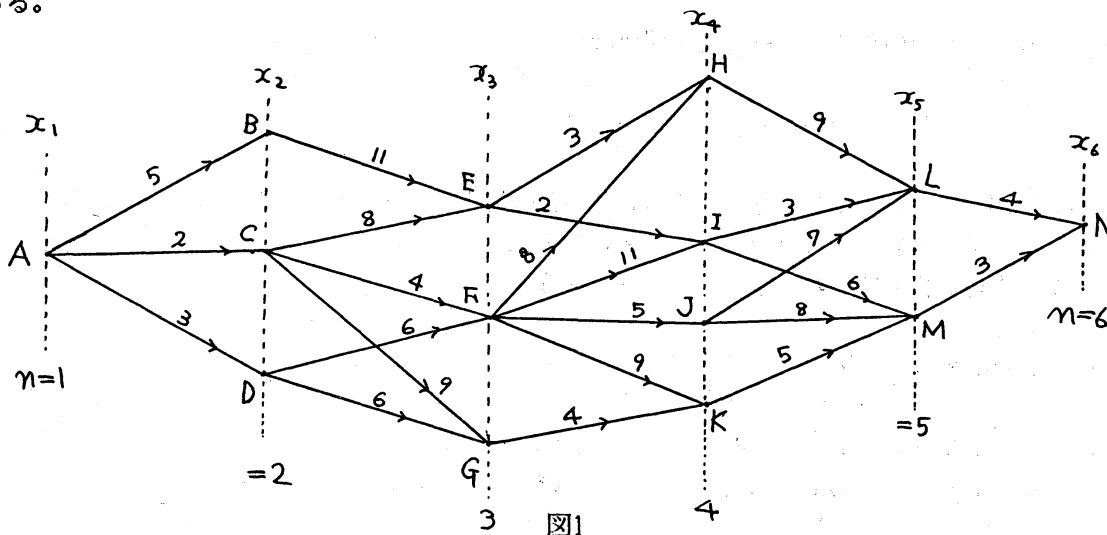


図1

このように各ルートに範囲を対応させる。このとき、範囲が最小になるルートを求めよう。これは最適化問題

$$\begin{aligned} \text{Min} \quad & \max_{1 \leq n \leq 5} g_n(x_n, x_{n+1}) - \min_{1 \leq n \leq 5} g_n(x_n, x_{n+1}) \\ \text{s.t.} \quad & (i) \quad x_{n+1} \in A_n(x_n) \quad 1 \leq n \leq 5 \end{aligned} \quad (7)$$

で表される。ただし、図1で示した時刻 n , 状態 x_n に対して $A_n(x_n)$ は点 x_n から直接行ける点 x_{n+1} の全体とし、 $g_n(x_n, x_{n+1})$ は辺 $x_n x_{n+1}$ 上の実数値とする。時刻 n における状態 x_n の全体を S_n とする。

この最適化問題を新しく実パラメータ b, c を導入した問題群

$$\begin{aligned} \text{Min} \quad & b \vee \bigvee_{k=n}^5 g_k(x_k, x_{k+1}) \vee k(x_6) - c \wedge \bigwedge_{k=n}^5 g_k(x_k, x_{k+1}) \wedge l(x_6) \\ \text{s.t.} \quad & (i) \quad x_{k+1} \in A_k(x_k) \quad n \leq k \leq 5 \end{aligned} \quad (8)$$

$$x_n \in S_n, \quad b, c \in \{1, 2, \dots, 12\}, \quad 1 \leq n \leq 5$$

に埋め込む。ここで、図1での最大値が 11 , 最小値が 2 に注意すれば、 b, c を有限集合 $\{1, 2, \dots, 12\}$ 内を動かせば十分であることがわかる。問題 (8) の最小値を $u^{6-n}(b, x_n, c)$ とすると、再帰式

$$\left\{ \begin{aligned} u^{6-n}(b, x_n, c) &= \min_{x_{n+1} \in A_n(x_n)} u^{5-n}(b \vee g_n(x_n, x_{n+1}), x_{n+1}, c \wedge g_n(x_n, x_{n+1})) \\ &\quad b, c \in \{1, 2, \dots, 12\}, \quad x_n \in S_n, \quad 1 \leq n \leq 5 \\ u^0(b, x_6, c) &= b \vee k(x_6) - c \wedge l(x_6) \\ &\quad b, c \in \{1, 2, \dots, 12\}, \quad x_6 \in S_6 \end{aligned} \right. \quad (9)$$

が成り立つ。簡単のために、終端利得関数はそれぞれ

$$k(N) = 1, \quad l(N) = 12$$

とすることができる。このとき、与えられた問題の最小値は $n = 1, x_1 = A, c = 12$ のときの $u^{6-n}(b, x_1, c)$ の値 $u^5(1, A, 12)$ で与えられる。

さて、上述の再帰式を解くと、次のようになる。

$$u^0(b, N, c) = b - c$$

$$u^1(b, L, c) = b \vee 4 - c \wedge 4,$$

$$\pi_5^*(b, L, c) = N$$

$$u^1(b, M, c) = b \vee 3 - c \wedge 3,$$

$$\pi_5^*(b, L, c) = N$$

$$u^2(b, H, c) = bv9 - c\Lambda4,$$

$$\pi_4^*(b, H, c) = L$$

$$u^2(b, I, c) = bv4 - c\Lambda3,$$

$$\pi_4^*(b, I, c) = \begin{cases} L \text{ or } M & \begin{cases} b \geq 6 \\ \text{のとき} \end{cases} \\ L & \begin{cases} 1 \leq b \leq 5 \end{cases} \end{cases}$$

$$u^2(b, J, c) = bv7 - c\Lambda4,$$

$$\pi_4^*(b, J, c) = \begin{cases} L \text{ or } M & \begin{cases} b \geq 8, c \leq 3 \\ \text{のとき} \end{cases} \\ L & \text{その他} \end{cases}$$

$$u^2(b, K, c) = bv5 - c\Lambda3,$$

$$\pi_4^*(b, K, c) = M$$

$$u^3(b, E, c) = bv4 - c\Lambda2,$$

$$\pi_3^*(b, E, c) = \begin{cases} H \text{ or } I & \begin{cases} (b \geq 9, c \leq 2) \\ \text{or } (b=8, c=3) \\ \text{その他 のとき} \end{cases} \\ I & \end{cases}$$

$$u^3(b, F, c) = bv7 - c\Lambda4,$$

$$\pi_3^*(b, F, c) = \begin{cases} H, I, J \text{ or } K & \begin{cases} b \geq 11, c \leq 3 \\ 9 \leq b \leq 10, c \leq 3 \end{cases} \\ H, J \text{ or } K & \begin{cases} 1 \leq b \leq 8 \\ b \geq 9, c \geq 4 \end{cases} \\ J & \text{のとき} \\ H \text{ or } J & \end{cases}$$

$$u^3(b, G, c) = bv5 - c\Lambda3,$$

$$\pi_3^*(b, G, c) = K$$

$$u^4(b, B, c) = bv11 - c\Lambda2,$$

$$\pi_2^*(b, B, c) = E$$

$$u^4(b, C, c) = bv7 - c\Lambda4,$$

$$\pi_2^*(b, C, c) = \begin{cases} E, F \text{ or } G & \begin{cases} b \geq 9, c \leq 2 \\ b=8, c \leq 2 \end{cases} \\ E \text{ or } G & \begin{cases} b \leq 7, c \leq 2 \\ b \geq 9, c=3 \end{cases} \\ F & \begin{cases} b \leq 8, c=3 \\ c \geq 4 \end{cases} \\ F \text{ or } G & \text{のとき} \\ F & \end{cases}$$

$$u^4(b, D, c) = (bv7 - c\Lambda4) \wedge (bv6 - c\Lambda3)$$

$$\pi_2^*(b, D, c) = \begin{cases} F \text{ or } G & \begin{cases} b \geq 7, c \leq 3 \\ b \leq 6, c \leq 3 \end{cases} \\ G & \begin{cases} b \leq 6, c \geq 4 \\ b \geq 7, c \geq 4 \end{cases} \\ F \text{ or } G & \text{のとき} \\ F & \end{cases}$$

$$u^5(b, A, c) = bv6 - c\Lambda3$$

$$\pi_1^*(b, A, c) = \begin{cases} B, C \text{ or } D & \begin{cases} b \geq 11, c \leq 2 \\ 7 \leq b \leq 10, c \leq 2 \end{cases} \\ C \text{ or } D & \begin{cases} 7 \leq b \leq 10, c \geq 3 \\ b \leq 6 \end{cases} \\ D & \text{のとき} \\ D & \end{cases}$$

したがって、求める最小値は $u^5(1, A, 12) = 3$ であり、初期状態 $s_1 = (1, A, 12)$ からの最適政策 $\{\pi_n^*\}_1^5$ による最適行動は

$$s_1 = (1, A, 12) \xrightarrow{D} \hat{s}_2 = (3, D, 3) \xrightarrow{G} \hat{s}_3 = (6, G, 3) \xrightarrow{K} \hat{s}_4 =$$

$$(6, K, 3) \xrightarrow{M} \hat{s}_6 = (6, M, 3) \xrightarrow{N} \hat{s}_6 = (6, N, 3)$$

となる。ゆえに、この範囲最小値問題は最南端ルート $A \rightarrow D \rightarrow G \rightarrow K \rightarrow M \rightarrow N$ で最小値 3 が達成されることになる。

注意 図1では $g_1(A, D) = 3$ であるが、これを $g_1(A, D) = 4$ に変更し、他のデータはそのままにすると、再帰式の解としては $u^5(b, A, c)$ と $\pi_1^*(b, A, c)$ のみが増加して、次のようになる。

$$u^5(b, A, c) = (bv7 - c\wedge 4) \wedge (bv6 - c\wedge 3)$$

$$\pi_1^*(b, A, c) = \begin{cases} B, C \text{ or } D \\ C, D \\ D \\ D \end{cases} \quad \begin{cases} b \geq 11, c \leq 2 \\ 7 \leq b \leq 10, c \leq 2 \\ 7 \leq b \leq 10, c \geq 3 \\ b \leq 6 \end{cases} \quad \text{のとき}$$

したがって、このときの求める最小値は

$$\begin{aligned} u^5(1, A, 12) &= (1v7 - 12\wedge 4) \wedge (1v6 - 12\wedge 3) \\ &= 3 \end{aligned}$$

になり、 $s_1 = (1, A, 12)$ からの最適政策による最適行動は途中の \hat{s}_2 から2つに分岐して

$$\begin{array}{ccccccc} & & \hat{s}_3 = (6, F, 4) & \xrightarrow{J} & \hat{s}_4 = (6, J, 4) & \xrightarrow{L} & \hat{s}_5 = (7, L, 4) \xrightarrow{N} \hat{s}_6 = (7, N, 4) \\ & \uparrow F & & & & & \\ s_1 = (1, A, 12) & \xrightarrow{D} & \hat{s}_2 = (4, D, 4) & & & & \\ & \downarrow G & & & & & \\ & \hat{s}_3 = (6, G, 4) & \xrightarrow{K} & \hat{s}_4 = (6, K, 4) & \xrightarrow{M} & \hat{s}_5 = (6, M, 4) & \xrightarrow{N} \hat{s}_6 = (6, N, 3) \end{array}$$

になる。ゆえに、 $g_1(A, D) = 4$ に変更した最小範囲問題は2つのルート $A \rightarrow D \rightarrow F \rightarrow J \rightarrow L \rightarrow N$ と $A \rightarrow D \rightarrow G \rightarrow K \rightarrow M \rightarrow N$ 上で最小値 3 をとる。

4.2 最小分散問題

同じく図1において、ルート上の5つの値を統計的データと解釈して、その分散を最小にするルートを求めることを考える。この問題は

$$\begin{aligned} \text{Min} \quad & \frac{1}{5} \sum_{n=1}^5 (g_n(x_n, x_{n+1}) - \frac{1}{5} \sum_{i=1}^5 g_n(x_n, x_{n+1}))^2 \\ \text{s.t.} \quad & (i) \quad x_{n+1} \in A_n(x_n) \quad 1 \leq n \leq 5 \end{aligned} \quad (10)$$

で表される。以下では分数計算より簡単な整数計算を行うために、この目的関数を25倍した

$$\begin{aligned} & 25 \cdot \frac{1}{5} \sum_{n=1}^5 (g_n(x_n, x_{n+1}) - \frac{1}{5} \sum_{i=1}^5 g_n(x_n, x_{n+1}))^2 \\ &= 5 \sum_{n=1}^5 g_n^2(x_n, x_{n+1}) - (\sum_{n=1}^5 g_n(x_n, x_{n+1}))^2 \end{aligned}$$

を目的関数にもつ最小値問題

$$\begin{aligned} \text{Min } & 5 \sum_{n=1}^5 g_n^2(x_n, x_{n+1}) - \left(\sum_{n=1}^5 g_n(x_n, x_{n+1}) \right)^2 \\ \text{s.t. (i) } & x_{n+1} \in A_n(x_n) \quad 1 \leq n \leq 5 \end{aligned} \quad (11)$$

を解こう。

さて、新しい非負パラメータ b を含む問題

$$\begin{aligned} \text{Min } & 5 \sum_{k=n}^5 g_k^2(x_k, x_{k+1}) + l(x_6) - \left(b + \sum_{k=n}^5 g_k(x_k, x_{k+1}) + k(x_6) \right)^2 \\ \text{s.t. (i) } & x_{k+1} \in A_k(x_k) \quad n \leq k \leq 5 \end{aligned} \quad (12)$$

$$b \geq 0, x_n \in S_n, \quad 1 \leq n \leq 6$$

の最小値を $v^{6-n}(b, x_n)$ とおくと、再帰式

$$\begin{cases} v^{6-n}(b, x_n) = \text{Min}_{x_{n+1} \in A_n(x_n)} [5g_n^2(x_n, x_{n+1}) + v^{5-n}(b + g_n(x_n, x_{n+1}), x_{n+1})] \\ \qquad \qquad \qquad b \geq 0, x_n \in S_n, \quad 1 \leq n \leq 5 \\ v^0(b, x_6) = l(x_6) - (b + k(x_6))^2 \qquad \qquad b \geq 0, x_6 \in S_6 \end{cases}$$

が成り立つ。ここで、終端利得を

$$l(N) = k(N) = 0$$

とすれば、問題(11)の最小値は、この再帰式を解いて、 $v^5(0, A)$ で与えられる。

さて、再帰式を解くと、次のようになる。

$$v^0(b, N) = -b^2$$

$$v^1(b, L) = 5 \cdot 16 - (b+4)^2, \quad \hat{\sigma}_5(b, L) = N$$

$$v^1(b, M) = 5 \cdot 9 - (b+3)^2, \quad \hat{\sigma}_5(b, M) = N$$

$$v^2(b, H) = 5 \cdot 97 - (b+13)^2, \quad \hat{\sigma}_4(b, H) = L$$

$$v^2(b, I) = \begin{cases} 5 \cdot 25 - (b+7)^2 \\ 5 \cdot 45 - (b+9)^2, \end{cases} \quad \hat{\sigma}_4(b, I) = \begin{cases} L \\ M \end{cases} \quad \begin{cases} 0 \leq b \leq 17 \\ b \geq 17 \end{cases} \quad \text{のとき}$$

$$v^2(b, J) = 5 \cdot 65 - (b+11)^2, \quad \hat{\sigma}_4(b, J) = L$$

$$v^2(b, K) = 5 \cdot 34 - (b+8)^2, \quad \hat{\sigma}_4(b, K) = M$$

$$v^3(b, E) = \begin{cases} 5 \cdot 29 - (b+9)^2 \\ 5 \cdot 106 - (b+16)^2, \end{cases} \quad \hat{\sigma}_3(b, E) = \begin{cases} I(L) \\ H \end{cases} \quad \begin{cases} 0 \leq b \leq 15 \\ b \geq 15 \end{cases} \quad \text{のとき}$$

$$\begin{aligned}
v^3(b, F) &= \begin{cases} 5 \cdot 90 - (b+16)^2 \\ 5 \cdot 161 - (b+21)^2, \end{cases} & \hat{\sigma}_3(b, F) &= \begin{cases} J & \begin{cases} 0 \leq b \leq 17 \\ b \geq 17 \end{cases} \end{cases} \text{ のとき} \\
v^3(b, G) &= 5 \cdot 50 - (b+12)^2, & \hat{\sigma}_3(b, G) &= K \\
v^4(b, B) &= \begin{cases} 5 \cdot 150 - (b+20)^2 \\ 5 \cdot 227 - (b+27)^2, \end{cases} & \hat{\sigma}_2(b, B) &= \begin{cases} E(I, L) & \begin{cases} 0 \leq b \leq 4 \\ b \geq 4 \end{cases} \end{cases} \text{ のとき} \\
v^4(b, C) &= \begin{cases} 5 \cdot 106 - (b+20)^2 \\ 5 \cdot 227 - (b+27)^2, \end{cases} & \hat{\sigma}_2(b, C) &= \begin{cases} F(J) & \begin{cases} 0 \leq b \leq 13 \\ b \geq 13 \end{cases} \end{cases} \text{ のとき} \\
v^4(b, D) &= \begin{cases} 5 \cdot 86 - (b+18)^2 \\ 5 \cdot 126 - (b+22)^2 \\ 5 \cdot 197 - (b+27)^2, \end{cases} & \hat{\sigma}_2(b, D) &= \begin{cases} G & \begin{cases} 0 \leq b \leq 5 \\ 5 \leq b \leq 11 \\ b \geq 11 \end{cases} \end{cases} \text{ のとき} \\
v^5(b, A) &= \begin{cases} 5 \cdot 95 - (b+21)^2 \\ 5 \cdot 135 - (b+25)^2 \\ 5 \cdot 206 - (b+30)^2 \\ 5 \cdot 252 - (b+32)^2, \end{cases} & \hat{\sigma}_1(b, A) &= \begin{cases} D(G) & \begin{cases} 0 \leq b \leq 2 \\ 2 \leq b \leq 8 \\ 8 \leq b \leq 53/2 \\ b \geq 53/2 \end{cases} \end{cases} \text{ のとき。}
\end{aligned}$$

したがって、問題(11)は最小値

$$v^5(0, A) = 5 \cdot 95 - 21^2 = 34$$

をもつ。初期状態 $s_1 = (0, A)$ からの最適政策 $\{\hat{\sigma}_n\}_1^5$ による最適行動は

$$\begin{aligned}
s_1 &= (0, A) \xrightarrow{D} \hat{s}_2 = (3, D) \xrightarrow{G} \hat{s}_3 = (9, K) \xrightarrow{K} \hat{s}_4 = (13, K) \xrightarrow{M} \\
&\hat{s}_5 = (18, M) \xrightarrow{N} \hat{s}_6 = (21, N)
\end{aligned}$$

になる。したがって、最南端ルート $A \rightarrow D \rightarrow G \rightarrow K \rightarrow M \rightarrow N$ が問題(11)の最小値

$$\begin{aligned}
v^5(0, A) &= 5(3^2 + 6^2 + 4^2 + 5^2 + 3^2) - (3+6+4+5+3)^2 \\
&= 5 \cdot 95 - 21^2 \\
&= 34
\end{aligned}$$

を与える。

ゆえに、最初に与えられた最小分散問題(10)は最南端ルート $A \rightarrow D \rightarrow G \rightarrow K \rightarrow M \rightarrow N$ 上で最小値 $34/25 = 1.36$ をもつ。

4.3 最小比問題

図2においても点 A から出発して左→右の方向に進んで点 N で終わるとする。このとき、

$$v^0(b, N, c) = b/c \quad b \geq 0, c > 0$$

(以下 $b, c \geq 0$ とする。)

$$\begin{aligned} v^1(b, L, c) &= (b+4)/(c+3), & \hat{g}_5(b, L, c) &= N \\ v^1(b, M, c) &= (b+3)/(c+5), & \hat{g}_5(b, M, c) &= N \end{aligned}$$

$$\begin{aligned} v^2(b, H, c) &= (b+13)/(c+7), & \hat{g}_4(b, H, c) &= L \\ v^2(b, I, c) &= (b+7)/(c+11), & \hat{g}_4(b, I, c) &= L \\ v^2(b, J, c) &= (b+11)/(c+8), & \hat{g}_4(b, J, c) &= M \\ v^2(b, K, c) &= (b+8)/(c+9), & \hat{g}_4(b, K, c) &= M \end{aligned}$$

$$\begin{aligned} v^3(b, E, c) &= (b+9)/(c+16), & \hat{g}_3(b, E, c) &= I \\ v^3(b, F, c) &= \begin{cases} (b+18)/(c+15) \\ (b+16)/(c+13) \end{cases}, & \hat{g}_3(b, F, c) &= \begin{cases} I & c \leq b+3 \\ J & c \geq b+3 \end{cases} \text{ のとき} \\ v^3(b, G, c) &= (b+12)/(c+16), & \hat{g}_3(b, G, c) &= K \end{aligned}$$

$$\begin{aligned} v^4(b, B, c) &= (b+20)/(c+18), & \hat{g}_2(b, B, c) &= E \\ v^4(b, C, c) &= \begin{cases} (b+17)/(c+20) \\ (b+22)/(c+22) \end{cases}, & \hat{g}_2(b, C, c) &= \begin{cases} E & 2b-5c \leq 66 \\ F(I) & 2b-5c \geq 66 \end{cases} \text{ のとき} \\ v^4(b, D, c) &= \begin{cases} (b+18)/(c+19) \\ (b+24)/(c+20) \end{cases}, & \hat{g}_2(b, D, c) &= \begin{cases} G & b-6c \leq 96 \\ F(I) & b-6c \geq 96 \end{cases} \text{ のとき} \end{aligned}$$

$$\begin{aligned} v^5(b, A, c) &= \begin{cases} (b+19)/(c+22) \\ (b+24)/(c+24) \end{cases}, & \hat{g}_1(b, A, c) &= \begin{cases} C(E) & 2b-5c \leq 72 \\ C(FI) & 2b-5c \geq 72 \end{cases} \text{ のとき} \end{aligned}$$

したがって、初期状態 $s_1 = (0, A, 0)$ からの最適政策 $\{\hat{g}_n\}_1^5$ による最適行動の状態列は

$$(0, A, 0) \longrightarrow (2, C, 2) \longrightarrow (10, E, 6) \longrightarrow (12, I, 11) \longrightarrow (15, L, 19) \longrightarrow (19, N, 22)$$

となる。したがって、この最小比問題はルート $A \rightarrow C \rightarrow E \rightarrow I \rightarrow L \rightarrow N$ 上で最小値 $v_4(0, A, 0) = 19/22$ を持つ。

参考文献

- [1] R. Bellman, Dynamic Programming, Princeton Univ. Press, Princeton, NJ, 1957.
- [2] R. Bellman, Introduction to the Mathematical Theory of Control Processes, Vol. I, Linear Equations and Quadratic Criteria, Academic Press, NY, 1967.

- [3] R. Bellman, Introduction to the Mathematical Theory of Control Processes, Vol.II, Nonlinear Processes, Academic Press, NY, 1971.
- [4] 岩本 誠一、 逐次決定過程としての動的計画論 (1)、 オペレーションズ・リサーチ 22 (1977)、 427-434。
- [5] 岩本 誠一、 逐次決定過程としての動的計画論 (2)、 オペレーションズ・リサーチ 22 (1977)、 496-501。
- [6] 岩本 誠一、 動的計画の理論と応用、 数学 31 (1979)、 331-348。
- [7] 岩本 誠一、 「動的計画論」、 九州大学出版会、 1987年。
- [8] A. Kaufman, Graphs, Dynamic Programming and Finite Games, Academic Press, NY, 1967.
- [9] L.G. Mitten, Composition principles for synthesis of optimal processes, Operations Res. 12(1964), 610-619.
- [10] G.L. Nemhauser, Introduction to Dynamic Programming, Wiley, NY, 1966.
- [11] M. Sniedovich, A class of nonseparable dynamic programming problems, J. Opt. Theo. Appl. 52(1987), 111-121.
- [12] M. Sniedovich, Analysis of a class of fractional programming problems, Math. Prog. 43(1989), 329-3